

Fecha de Publicación: 15 de septiembre de 2020

Fecha de Información: 11 de septiembre de 2020 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1692.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupa y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|---------------|---------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 220.8 | 213.3 | 94.5 | 167.0 | 70.8 | 5.8 | 48.0 |
| 15-35 | 493.8 | 678.4 | 501.0 | 105.6 | 32.4 | 243.3 | 145.0 |
| 36-60 | 2.2 | 38.5 | 30.0 | 0.0 | 8.5 | 2.2 | 0.0 |
| 61-90 | 20.8 | 53.0 | 40.0 | 0.0 | 3.0 | 10.8 | 10.0 |
| 91-180 | 6.4 | 26.1 | 10.0 | 0.0 | 11.1 | 1.4 | 5.0 |
| >180 | 50.0 | 102.0 | 64.8 | 44.4 | 32.2 | 0.5 | 5.0 |
| Total | 794.0 | 1111.2 | 740.3 | 317.0 | 157.9 | 264.0 | 213.0 |

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

| Rango | Sector Financiero* | Otros Agentes sin intragrupo | | Total |
|--------------|--------------------|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 2.3 % | 2.3 % | 1.9 % | 2.1 % |
| 15-35 | 2.2 % | 2.3 % | 2.2 % | 2.3 % |
| 36-60 | - | 2.3 % | 2.0 % | 2.3 % |
| 61-90 | 2.3 % | 2.3 % | 2.2 % | 2.3 % |
| 91-180 | 2.3 % | 2.4 % | 2.2 % | 2.4 % |
| >180 | 2.2 % | 2.4 % | 2.1 % | 2.4 % |
| Total | 2.2 % | 2.3 % | 2.1 % | 2.2 % |

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

| Sector | 7 al 11 de septiembre | | | | 14 al 18 de septiembre | | | | 21 al 25 de septiembre | | | |
|----------------------------------|-----------------------|------------|--------------|--------------|------------------------|------------|-------------|-------------|------------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 30 | 142 | 7962 | 7845 | 39 | 123 | 4447 | 5266 | 38 | 109 | 3884 | 4297 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 4197 | 3614 | 0 | 0 | 3271 | 2087 | 0 | 0 | 2478 | 1117 |
| Otros | 142 | 30 | 1011 | 1711 | 123 | 39 | 796 | 1161 | 109 | 38 | 477 | 1425 |
| Total | 172 | 172 | 13170 | 13170 | 162 | 162 | 8514 | 8514 | 147 | 147 | 6839 | 6839 |

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.